

**ПАСПОРТ ВНЕБИРЖЕВОГО ОПЦИОННОГО ДОГОВОРА
«ВЕЛИКОЛЕПНЫЙ ФЕНИКС С ОПЦИЯМИ РАСЧЕТНЫЙ НЕФТЬ КУПОННЫЙ 16.07.2025»¹**

Этот документ предназначен для информирования Вас как инвестора (клиента брокера)² об основных характеристиках данного финансового инструмента (далее – **Опционный договор**), связанной с ним структуре расходов, наличии ограничений на досрочный выход из инвестиций и о существенных рисках.

1. Это важно:

- 1.1. Представленная информация не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией, а также не является рекламой.
- 1.2. Финансовый инструмент не является банковским депозитом, связанные с ним риски не подлежат страхованию в соответствии с Федеральным законом от 23 декабря 2003 года № 177-ФЗ «О страховании вкладов в банках Российской Федерации». Возврат инвестиций и доходность вложений в данный финансовый инструмент не гарантированы государством.
- 1.3. Данный финансовый инструмент может быть труден для понимания.
- 1.4. Перед подачей поручения брокеру на заключение Опционного договора следует ознакомиться с указанной ниже информацией.

2. Что представляет собой финансовый инструмент:

1. Краткая информация об Опционном договоре	
Вид финансового инструмента	Расчетный внебиржевой опционный договор. Базисным активом является российская ценная бумага.
Категория инвестора, которой предназначен финансовый инструмент	Юридическое лицо, Квалифицированный инвестор – физическое лицо.
2. Информация о разработчике Опционного договора	
Полное или краткое наименование	ООО «Компания БКС» ³
Контакты	630099, г. Новосибирск, ул. Советская, д. 37 / 129110, г. Москва, пр. Мира, д.69 стр.1
3. Информация о паспорте Опционного договора	
Дата разработки паспорта финансового инструмента	10.08.2023 г.
Дата последней актуализации паспорта финансового инструмента	10.08.2023 г.
4. Информация о разработчике паспорта Опционного договора	
Полное или краткое наименование	ООО «Компания БКС»
Контакты	Аналогичны контактам разработчика Опционного договора

Описание Опционного договора

Опционный договор – это договор, по условиям которого право требовать получения дохода и его величина, а также сумма возврата вложенных инвестиций зависит от наступления определенных условий, а именно от достижения определенных значений базисных активов в определенные даты. Выплачиваемая инвестору в связи с завершением срока действия Опционного договора сумма денежных средств может быть существенно меньше суммы инвестированных средств. Все платежи по Опционному договору производятся только в рублях в безналичном порядке.

Механизм действия Опционного договора:

Для расчетов по Опционному договору используются в том числе Номинал контракта в Валюте контракта и коэффициенты, значения которых фиксируются в поручении брокеру на заключение Опционного договора.

У Инвестора возникает право требования получения Промежуточной выплаты по Опционному договору при наступлении следующих условий и в следующем размере:

¹ Далее по тексту – **Паспорт**.

² Далее по тексту – **инвестор**.

³ Общество с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (ОГРН: 1025402459334).

➤ если на Дату промежуточной фиксации до автоматического досрочного прекращения Опционного договора, на Дату исполнения контракта все определенные на такую дату Промежуточные значения Базисных активов больше или равны определенному в таблице № 3 уровня % от соответствующих Первоначальных значений Базисных активов:

Таблица № 3

Дата определения Промежуточный выплаты	Условие для возникновения права требования Промежуточный выплаты
17.08.2024	0 % от соответствующих Первоначальных значений Базисных активов
16.07.2025	0 % от соответствующих Первоначальных значений Базисных активов

Сумма Промежуточной выплаты при возникновении у инвестора права требования Промежуточной выплаты по Опционному договору рассчитывается (далее – **Промежуточная выплата**). При возникновении у инвестора права требования Промежуточной выплаты по Опционному договору такое право требования считается предъявленным инвестором автоматически в дату возникновения у инвестора такого права требования. Сумма Промежуточной выплаты в Валюте контракта рассчитывается так:

в ином случае, Сумма Промежуточной выплаты в Валюте контракта рассчитывается так:

Дата определения Промежуточный выплаты	Условие	Сумма Промежуточной выплаты в Валюте контракта
17.08.2024	если все определенные на такую дату Промежуточные значения Базисных активов, больше или равны 120 % от соответствующих Первоначальных значений Базисных активов	15.0411 % от Номинала контракта в Валюте контракта
16.07.2025	если все определенные на такую дату Промежуточные значения Базисных активов, больше или равны 120 % от соответствующих Первоначальных значений Базисных активов	13.6849 % от Номинала контракта в Валюте контракта

в ином случае, Сумма Промежуточной выплаты в Валюте контракта рассчитывается так:

Дата определения Промежуточный выплаты	Сумма Промежуточной выплаты в Валюте контракта
17.08.2024	13.0356 % от Номинала контракта в Валюте контракта
16.07.2025	11.8603 % от Номинала контракта в Валюте контракта

При наступлении условия и предъявления права требования Промежуточной выплаты также для целей выплаты рассчитываются невыплаченные ранее Суммы Промежуточных выплат в Валюте Контракта (далее – **Суммы Промежуточных выплат в Валюте Контракта по эффекту памяти**) за период с даты заключения Опционного договора до Даты определения Промежуточный выплаты, на которую у инвестора возникло право требования Промежуточной выплаты (далее – **Дата реализации эффекта памяти**). Размер каждой из Сумм Промежуточных выплат в Валюте Контракта по эффекту памяти определяется в порядке, аналогичном тому, который применен для определения Суммы Промежуточной выплаты в Валюте Контракта на Дату реализации эффекта памяти.

Условия для основной выплаты по Опционному договору в связи с отсутствием наступления условия для автоматического досрочного прекращения Опционного договора:

если все определенные на Дату исполнения контракта Итоговые значения Базисных активов, будут больше или равны 100 % от соответствующих Первоначальных значений Базисных активов, то инвестору выплачивается в рублях денежная сумма, эквивалентная 100 % Номинала контракта в Валюте контракта	если на Дату исполнения контракта Итоговое значение одного и более Базисного актива будет меньше 100 % от соответствующих Первоначальных значений Базисных активов, то инвестору выплачивается в рублях денежная сумма 100 % Номинала контракта в Валюте контракта
--	--

Ключевые характеристики Опционного договора	
Минимальная сумма инвестиций	Коэффициент риска, % годовых
300000 рублей	0.0
Номинал контракта	Валюта контракта

Не уплачивается инвестором и используется исключительно в целях определения размера обязательств по Опционному договору. Размер Номинала контракта устанавливается по согласованию с инвестором.	Российский рубль	
Даты промежуточной фиксации	Даты определения параметров	
1. 17.08.2024 г. 2. 16.07.2025 г.	1. 17.08.2023 г.	
Базисные активы	Валюта Базисного актива	Биржа для определения значения Базисного актива
1 (одна) обыкновенная акция ПАО "ЛУКОЙЛ", RU0009024277	Российский рубль	ПАО Московская Биржа
1 (одна) обыкновенная акция ПАО "Газпром", RU0007661625	Российский рубль	ПАО Московская Биржа
1 (одна) обыкновенная акция ПАО «НК «Роснефть», RU000A0J2Q06	Российский рубль	ПАО Московская Биржа
1 (одна) обыкновенная акция ПАО "ТАТНЕФТЬ", RU0009033591	Российский рубль	ПАО Московская Биржа
Срок для уплаты Промежуточной выплаты по Опционному договору	Ценовой коэффициент	
не позднее двух рабочих дней, следующих за датой, на которую возникла обязанность по ее уплате с учетом реализации инвестором права требования её выплаты	1.0	
Срок для уплаты основной выплаты по Опционному договору	Дата исполнения контракта	
не позднее двух рабочих дней, следующих за Датой исполнения контракта	16.07.2025	
Первоначальное, Промежуточное и Итоговое значение Базисного актива.	Порядок определения значений Базисного актива в валюте Базисного актива	
Первоначальное значение Базисного актива устанавливается на Дату определения параметров. Промежуточное значение Базисного актива устанавливается на Дату промежуточной фиксации, Дату исполнения Контракта. Итоговое значение Базисного актива устанавливается на Дату исполнения Контракта	Первоначальное значение Базисного актива, Промежуточное значение Базисного актива, Итоговое значение Базисного актива определяются на соответствующую дату в порядке, установленном поручением Инвестора, а также в разделе 8 Приложения № 6 к Регламенту (https://broker.ru/f/reg/bcs_futures.pdf), с учетом установленной Биржи для определения значения этого Базисного актива.	

Порядковый номер	Дата наблюдения, t_j	Добавочный коэффициент № 1, α_j^1	Добавочный коэффициент № 2, α_j^2	Досрочный коэффициент, β_j	Коэффициент ожидаемой доходности № 1 ⁴ , R_j^1	Коэффициент ожидаемой доходности № 2, R_j^2
1	17.08.2024	0.0	1.2	100.0	0.130356	0.150411
2	16.07.2025	0.0	1.2	—	0.118603	0.136849

Индикатор риска Опционного договора и возможные сценарии выплат.

Сводный индикатор риска

1	2	3	4	5	6	7
←			→			
Низкий риск						
			Высокий риск			

⁴ Коэффициент «ожидаемая доходность» используется исключительно для расчетов по Поручению и не должен восприниматься Клиентом в качестве заверения/гарантии того, что Клиентом в результате исполнения Поручения будет получена доходность в соответствующем данному коэффициенту размере.

Сводный индикатор риска показывает уровень риска этого финансового инструмента по сравнению с другими инструментами. Он показывает, насколько велика вероятность, что инвестор потеряет деньги, инвестированные в Опционный договор, из-за изменений на рынках или из-за того, что ему не смогут заплатить. Данный Опционный договор классифицирован ООО «Компания БКС» как 6 из 7, что составляет второй по величине класс риска. Это означает оценку уровня потенциальных убытков от результатов инвестирования в Опционный договор как высоких. Плохие рыночные условия очень вероятно повлияют на возможности другой стороны произвести купонные выплаты или их размер, возврата начальных инвестиций по Опционному договору или размер такого возврата. Валютный риск не учитывается в показанном выше сводном индикаторе риска.

Период инвестирования в Опционный договор равен сроку действия Опционного договора, зависит от потребностей инвестора и определяется им самостоятельно. Рекомендуемый период инвестирования – до даты исполнения Опционного договора

Сценарии выплат.

Инвестиции RUB 100 000			
Сценарии		12 месяцев	22 месяцев (Рекомендованный период владения)
Стрессовый сценарий	Что инвестор может получить обратно за вычетом затрат:	RUB 112724.09	RUB 126109.93
	Средний доход каждый год:	12.71%	12.90%
Неблагоприятный сценарий	Что инвестор может получить обратно за вычетом затрат:	RUB 113011.72	RUB 126109.93
	Средний доход каждый год:	13.00%	12.90%
Умеренный сценарий	Что инвестор может получить обратно за вычетом затрат:	RUB 114246.67	RUB 126109.93
	Средний доход каждый год:	14.23%	12.90%
Благоприятный сценарий	Что инвестор может получить обратно за вычетом затрат:	RUB 115129.55	RUB 142975.63
	Средний доход каждый год:	15.11%	20.56%

В этой таблице показаны деньги, которые инвестор мог бы получить обратно в течение рекомендуемого периода владения при различных сценариях, предполагая, что инвестирует в Форвардный договор 100 000 рублей. Расчеты производятся исходя из рекомендуемого периода владения.

Представленный расчет доходности в данных сценариях носит информационный характер, представляет собой прогноз (оценку) будущих результатов инвестиций, основанный на ценах/значениях прошлых периодов, не является точным показателем, а также не является точным указанием того, что инвестор может получить обратно и не является гарантией получения дохода от инвестиций в Опционный договор. То, что получит инвестор, будет зависеть от того, как движется рынок, как будет изменяться цена/значение базового актива и периода действия финансового инструмента до его прекращения или продажи. Можно сравнить их со сценариями других финансовых инструментов или продуктов. Инвестор должен помнить, что результаты инвестиций в финансовые инструменты, а также значения/цены базисных активов в прошлом не определяют результаты инвестиций, а также значения/цены базисных активов в будущем. Стрессовый сценарий показывает, что инвестор может получить обратно в экстремальных рыночных условиях, и не принимает во внимание ситуацию, когда сторона по Опционному контракту не сможет осуществить выплату, а ручательство по Опционному договору будет отсутствовать.

Приведенные цифры включают все затраты на сам финансовый инструмент, но не включают брокерскую и депозитарную комиссию, а также не включают расходы, которые инвестор несет за оказание ему иных услуг. Цифры не учитывают личную налоговую ситуацию Инвестора, которая также может повлиять на размер дохода.

Инвестирование в Опционный договор означает предположение Инвестора, что по его мнению цена/значение базового актива увеличится.

Максимальный убыток инвестора будет заключаться в том, что инвестор потеряет все свои инвестиции в Опционный договор, а также понесет расходы, связанные с таким инвестированием.

3. Что произойдет, если сторона по Опционному договору не сможет исполнить свои обязательства

В случае частичного или полного дефолта (банкротства) контрагента по Опционному договору инвестор может частично или полностью потерять вложенные инвестиции. Брокер не отвечает перед инвестором, во исполнение поручения которого заключен Опционный договор с контрагентом, за неисполнение таким контрагентом Опционного договора за исключением наличия ручательства брокера за исполнение Опционного договора в объеме этого ручательства или случаев, предусмотренных законом.

4. Как долго рекомендуется владеть финансовым инструментом, возможен ли досрочный возврат инвестиций

Период инвестирования в Опционный договор зависит от потребностей инвестора и определяется им самостоятельно.

Опционный договор может быть автоматически досрочно прекращен при наступлении условия для его автоматического досрочного прекращения. В таком случае, срок действия Опционного договора окажется меньше того, на который инвестор рассчитывал.

Возможность одностороннего отказа от Опционного договора по инициативе брокера или инвестора не предусмотрена.

Досрочное расторжение Опционного договора возможно при согласии контрагента по Опционному договору. При досрочном расторжении Опционного договора возврат вложенных инвестиций осуществляется не в полном объеме в соответствии со сложившейся на момент досрочного расторжения рыночной конъюнктурой, что влечет финансовые потери для инвестора.

5. Какие риски несет финансовый инструмент

Инвестирование в Опционный договор связано в том числе со следующими рисками:

➤ Рыночный риск.

Риск неблагоприятного изменения значений базисных активов Опционного договора, в результате чего инвестор может не только не получить доход в ожидаемом размере, но и лишиться части или всех вложенных инвестиций.

➤ Риск ликвидности.

Проявляется в возможности возникновения у инвестора финансовых потерь в связи с досрочным расторжением Опционного договора либо наоборот, в связи с невозможностью его досрочного расторжения;

6. Какова структура расходов

Сумма инвестиций в Опционный договор определяется инвестором по своему усмотрению, но не может быть менее Минимальной суммы инвестирования и осуществляется в рублях. За исполнение брокером поручения инвестора на заключение Опционного договора инвестор уплачивает брокеру вознаграждение. Инвестор также может нести расходы в связи с исполнением обязанности по уплате налоговых платежей. Размер налоговой ставки и порядок уплаты налогов в отношении доходов по Опционному договору зависит от применимого к инвестору налогового законодательства, международных договоров об избежании двойного налогообложения. Обязанность по несению иных расходов может вытекать из особенностей применимого к инвестору законодательства, соглашений.

При неблагоприятном для инвестора изменении значений базисных активов на определенные в Опционном договоре даты инвестор может лишиться части или всех вложенных инвестиций. При досрочном расторжении Опционного договора возврат вложенных инвестиций осуществляется не в полном объеме в соответствии со сложившейся на момент досрочного расторжения рыночной конъюнктурой.

7. Кому жаловаться

Жалобы и обращения необходимо направлять на почтовый адрес разработчика паспорта Опционного договора: 630099, г. Новосибирск, ул. Советская, д. 37 / 129110, г. Москва, пр. Мира, д.69 стр.1.

8. Иная важная информация

- Паспорт не является офертой, в том числе публичной, а также не является приглашением делать оферты. Паспорт носит исключительно информационный характер для сравнения основных характеристик Опционного договора с другими финансовыми инструментами и не содержит в себе исчерпывающей информации об Опционном договоре и связанных с ним рисках;
- Опционный договор не является ценной бумагой. Инвестирование не осуществляется напрямую в ценные бумаги, составляющие базисный актив Опционного договора. Опционный договор невозможно перевести на другой брокерский счет, индивидуальный инвестиционный счет;
- Коэффициенты дополнительной выплаты и ожидаемой доходности используются исключительно для расчетов и не должны восприниматься в качестве заверения/гарантии выплаты инвестору дополнительной выплаты или доходности;

- инвестору перед подачей брокеру поручения на заключение Опционного договора необходимо получить все необходимые ему консультации от независимых лиц по юридическим, налоговым, бухгалтерским и иным вопросам, а также оценить риски наступления возможных неблагоприятных финансовых последствий и принять решение об их приемлемости для инвестора в свете его опыта работы на финансовом рынке, уровня соответствующих знаний инвестора, инвестиционных целей, уровня финансовых возможностей и сбережений, допустимого риска и ожидаемой доходности. Инвестор не должен инвестировать в Опционный договор, если он не понимает и не готов принять на себя риски, связанные с этим.